





PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDORES
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS N° 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N° 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR	Nº / ANO:	132 /2019 GI	
Unidade Gestora do RPPS	OF. Nº:	132 /2019 GI	
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores	Data:	17/05/19	
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:			
R\$ 2.089.178,13		Fundos Renda fixa em geral - Art. 7º, IV, "a"	
Dois milhões, oitenta e nove mil, cento e setenta e oito reais e treze centavos			
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO		
CNPJ do Fundo:	19.542.287/0001-00		
Segmento:	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior		
Tipo de Ativo:	FIDCs - Aberto ou Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"		
Tipo de operação realizada:	Resgate		
Valor da operação:	R\$ 2.089.178,13		
Quantidade de Cotas:	2.999,99999720		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 696,39271		
Data da Operação:	17/05/2019		
Data de Liquidação:	17/05/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	167.134.250,56	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		1,250%	
Limite Máximo por PL do fundo		5,00%	
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30/10/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS		R\$ 71.705.798.060,00	
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.		17,71%	
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30/10/2018		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	71.353.527.620,04	
% Recursos do Gestor com RPPS		20,58%	
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Forte		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim		
Distribuidor	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018		

Data de Início FI:		23/01/2014
Taxa Administração do FI (%):		0,45
Índice de Referência do FI:		IPCA + 11,90%
Tx Performance do FI (%):		Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref. Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):		Não possui
Tx Performance (% a superar. Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):		Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		Fitch Ratings
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		BB+
Carência (dias):		
Data Listagem Bolsa:		28/02/2019
Resgate (dias):		Não listado
Cód. Negociação Bolsa:		0
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		Não listado
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		INVESTIDOR QUALIFICADO
CNPJ do Fundo:		Não
Segmento:		0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		R\$ 0,00
		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O Fundo é uma comunhão de recursos destinados, preponderantemente, à aquisição de Direitos Creditórios, de acordo com a Política de Investimento descrita no Capítulo Seis do Regulamento
	Principais riscos do fundo:	Os Direitos Creditórios Cedidos e os Ativos Financeiros, por sua própria natureza, estão sujeitos a diversos riscos, incluindo, mas não se limitando a flutuações de mercado e/ou a riscos de crédito das respectivas contrapartes que poderão gerar perdas ao Fundo e aos Cotistas, bem como os demais riscos contantes do regulamento do fundo. (Risco - 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Curto Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		1,27%
Retorno Médio Anual		16,30%
Retorno Total		112,77%

Maior Retorno		2,27%
Menor Retorno		0,05%
Qtde. mês Positivo		60
Qtde. mês Negativo		0
Qtde. mês acima do Benchmark		25
Qtde. mês abaixo do Benchmark		35
Risco Mensal Período		0,35%
Risco Mensal 12 MESES		0,31%
Risco Anual do Período		1,20%
Retorno Relativo ao Benchmark		-1,71%
Sharpe		4,75
Information Ratio		0,34
Tracking Error		1,17%
VAR HISTÓRICO (95%)		1,84%
VAR 12 MESES (95%)		1,83%
Sharpe Modificado		16,23
Beta (12 meses)		0,14
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,34%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim. Havendo a necessidade do Atestado de Compatibilidade somente quando da aplicação de recursos em razão do longo prazo de carência e/ou resgate.	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/05/2019
Outras Observações:		
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?		Sim
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?		Sim
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?		Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?		Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?		Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?		Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, VII, "a"		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?		Sim
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?		Sim
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?		Não comprovado
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?		Não
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?		Sim
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 8º, IV, "a"		
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?		Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantém a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?

Pergunta não se aplica ao fundo

O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?

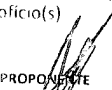

Pergunta não se aplica ao fundo

O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?

Pergunta não se aplica ao fundo

Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO		
CNPJ do Fundo:	11.060.913/0001-10		
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos		
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 2.089.178,13		
Quantidade de Cotas:	754.943,8935223		
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,76733		
Data da Operação:	17/05/2019		
Data de Liquidação:	17/05/2019		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	9.664.181.950,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	0,02%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	30/10/2018		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 72.795.798.060,00		
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	17,71%		
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	30/10/2018		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	71.353.527.620,04	
% Recursos do Gestor com RPPS	29,58%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Forte		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	30/10/2018		
Data de Início FI:	28/05/2010		
Taxa Administração do FI (%):	0,20		
Índice de Referência do FI:	IMA-B 5		
Tx Performance do FI (%):	Não possui		
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ. Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui		
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui		
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado		

Carência (dias):		0 dias
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		0
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não
CNPJ do Fundo:		0,00
Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice do Índice de Mercado ANBIMA série B 5 - IMA-B 5, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O prazo médio da carteira do FUNDO será superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. Verdada ao FUNDO a aplicação de recursos em cotas de fundos de investimento, de qualquer modalidade.
	Principais riscos do fundo:	O cotista está sujeito aos seguintes riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO aplica seus recursos. Risco de mercado: variação dos preços e cotações de mercado dos ativos que compõem a carteira do FUNDO e os demais riscos constantes do regulamento do fundo. (Risco 3)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Curto Prazo
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal		0,96%
Retorno Médio Anual		12,19%
Retorno Total		160,76%
Maior Retorno		3,61%
Menor Retorno		1,59%
Qtde. mês Positivo		90
Qtde. mês Negativo		10
Qtde. mês acima do Benchmark		15
Qtde. mês abaixo do Benchmark		85
Risco Mensal Período		0,84%
Risco Mensal 12 MESES		1,14%
Risco Anual do Período		2,90%
Retorno Relativo ao Benchmark		2,12%
Sharpe		0,71
Information Ratio		1,82
Tracking Error		0,16%
VAR HISTÓRICO (95%)		2,34%
VAR 12 MESES (95%)		2,16%
Sharpe Modificado		0,96
Beta (12 meses)		0,92
Erro Quadrático Médio (EQM)		0,05%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate.	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações.	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	14/05/2019

Outras Observações:		
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?		Pergunta não se aplica ao fundo
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?		Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, VII, "a"		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?		Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?		Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?		Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?		Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 8º, IV, "a"		
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?		Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?		Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?		Pergunta não se aplica ao fundo
Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)		
 PROPOSTANTE Anderson Carlos Gomes de Oliveira Chefe de Departamento de Investimentos CPF: 052.430.264-25 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 05/12/2020		 GESTOR/AUTORIZADOR José Marcos Alves de Barros Gerente de Investimentos CPF: 89.874.354-00 Entidade Certificadora: ANBIMA CPA 20 e CEA Validade da Certificação: 21/11/2020

SAÚDE
RECIFE

Recife, 17 de maio de 2019

RECI
PREV


Ofício RECIPREV nº 132/2019 – GI

Senhora Gerente,

Solicitamos aplicar o valor de R\$ 2.089.178,13 (Dois milhões, oitenta e nove mil, cento e setenta e oito reais e treze centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 11.060.913/0001-10, vinculado à conta 4-5.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 049/2019

Atenciosamente,


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


ELCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES
GERENTE ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO

Ilma Senhora
MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

OK
17/05/19

:: CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

17/05/2019

Características

CNPJ: 11.060.913/0001-10
 Gestor: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 251496
 Início do Fundo: 09/07/2010

Informações Operacionais

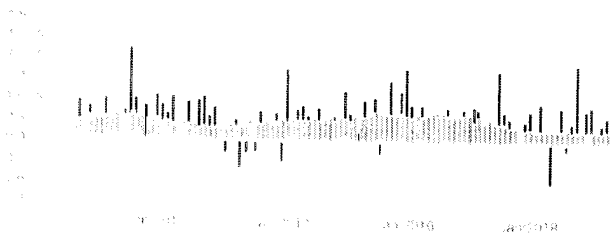
Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18	out/18	set/18	ago/18	jul/18	jun/18	mai/18
Fundo	176,73	4,22	10,76	21,96	37,76	1,08	0,76	0,52	1,53	1,38	0,13	3,10	0,86	-0,27	1,46	0,42	-1,59
% do CDI	130,93	180,15	168,24	147,27	124,50	208,01	163,06	106,14	282,28	279,27	27,30	570,35	183,03	-47,67	269,61	81,30	-306,67
CDI	134,98	2,34	6,40	14,91	30,33	0,52	0,47	0,49	0,54	0,49	0,49	0,54	0,47	0,57	0,54	0,52	0,52
Ibovespa	41,77	2,40	5,71	33,25	69,57	0,98	-0,18	-1,86	10,82	-1,81	2,38	10,19	3,48	-3,21	8,88	-5,20	-10,87
IBX	87,92	2,86	7,41	34,01	72,11	1,06	-0,11	-1,76	10,71	-1,29	2,66	10,42	3,23	-3,13	8,84	-5,19	-10,91
IGP-M	70,96	3,34	8,20	11,35	14,39	0,92	1,26	0,88	0,01	-1,08	-0,49	0,89	1,52	0,70	0,51	1,87	1,38

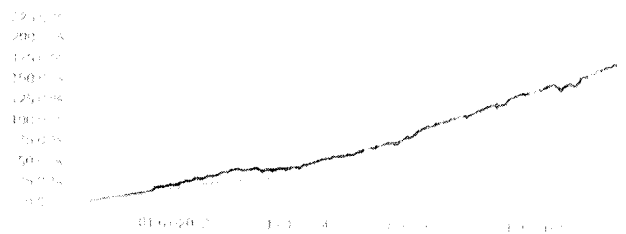
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezez Acima do Benchmark
Fundo	2,767329	9.664.181,95	8.721.348,34	3,06%	-2,41%	1,45%	3,74	3,06%	3,10%	-0,27%	8
CDI	-	-	-	0,00%	-	0,00%	1,00	0,00%	0,57%	0,47%	0

Gráficos

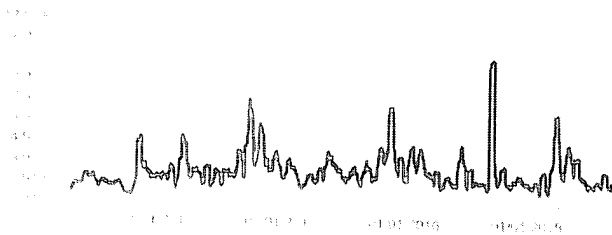
Retorno Mensal - 12/07/2010 a 17/05/2019 (mensal)



Retorno Acumulado - 12/07/2010 a 17/05/2019 (diária)



Volatilidade Anualizada - 12/07/2010 a 17/05/2019 (diária)



Risco x Retorno - 12/07/2010 a 17/05/2019 (diária)



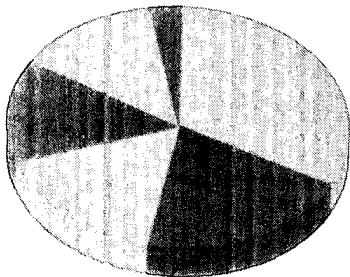
As informações contidas neste relatório são provenientes de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis. Não há responsabilidade pela veracidade e/ou atualidade das informações contidas neste relatório. O investidor deve realizar sua própria análise de risco e não deve considerar as informações contidas neste relatório como recomendação de compra ou venda de qualquer produto financeiro. O investidor deve considerar as informações contidas neste relatório apenas como referência para a tomada de decisão. O investidor deve considerar as informações contidas neste relatório apenas como referência para a tomada de decisão. O investidor deve considerar as informações contidas neste relatório apenas como referência para a tomada de decisão.

:: CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

17/05/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

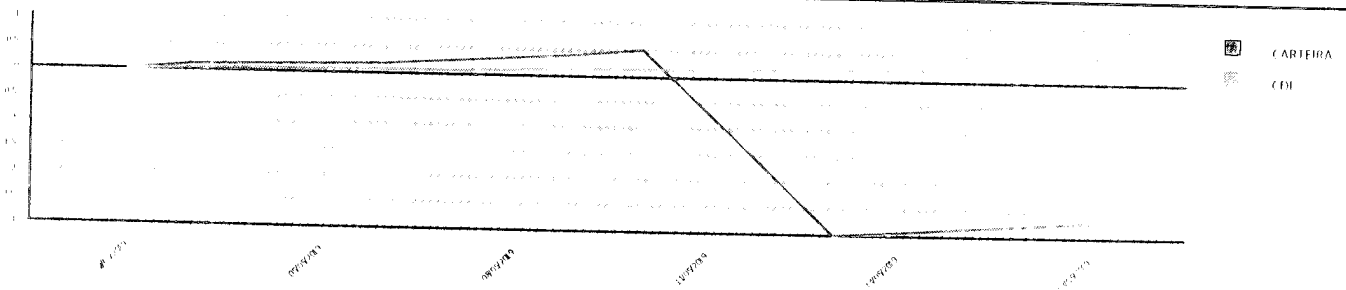
abr/2019



NTN-B - Venc.: 15/08/2022	32.35 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	20.32 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	16.76 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	13.85 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2019	13.67 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2019	3.06 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0.00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0.00 %
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0.00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0.00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0.00 %
Outras Disponibilidades	6.00 %
Outros Valores a receber	0.00 %

As informações são relativas a parte de títulos públicos ou privados, consideradas companhias, cuja responsabilidade pela entrega e entrega não é garantida pelo GUB. O FUNDI não garante a entrega dos títulos e nem a liquidação das empresas do seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como recomendação de investimento. O FUNDI não garante a entrega dos títulos e nem a liquidação das empresas do seu grupo empresarial. Os valores de investimento não constam como garantia de Administração do fundo. O perfil da carteira de títulos pode mudar ao longo do tempo devido a alterações de preços e taxas de juros. O rendimento obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimento são de médio prazo e podem sofrer alterações sem aviso prévio. O FUNDI não garante a entrega dos títulos e nem a liquidação das empresas do seu grupo empresarial. Os valores de investimento não constam como garantia de Administração do fundo. O perfil da carteira de títulos pode mudar ao longo do tempo devido a alterações de preços e taxas de juros. O rendimento obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimento são de médio prazo e podem sofrer alterações sem aviso prévio. O FUNDI não garante a entrega dos títulos e nem a liquidação das empresas do seu grupo empresarial. Os valores de investimento não constam como garantia de Administração do fundo. O perfil da carteira de títulos pode mudar ao longo do tempo devido a alterações de preços e taxas de juros. O rendimento obtido no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias de investimento são de médio prazo e podem sofrer alterações sem aviso prévio.

Data	Patrimônio Líquido	Quantidade de Cotas	Valor da Cota	Rentabilidade Dia		Rentabilidade Acumulada		% Sobre Ind
				% Carteira	% Indexador	% Carteira	% Indexador	
COTA SENIOR								
02/05/2019	171.787.165,20	240.000,00000000	715,77985500	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
03/05/2019	171.931.426,56	240.000,00000000	716,38094400	0,08	0,02	0,08	0,02	341,09
06/05/2019	172.075.809,12	240.000,00000000	716,98253800	0,08	0,02	0,17	0,05	341,19
07/05/2019	172.220.313,12	240.000,00000000	717,58463800	0,08	0,02	0,25	0,07	341,29
08/05/2019	172.364.938,32	240.000,00000000	718,18724300	0,08	0,02	0,34	0,10	341,40
09/05/2019	172.509.684,96	240.000,00000000	718,79035400	0,08	0,02	0,42	0,12	341,50
10/05/2019	172.654.553,28	240.000,00000000	719,39397200	0,08	0,02	0,50	0,15	341,60
13/05/2019	166.663.920,00	240.000,00000000	694,43300000	-3,47	0,02	2,98	0,17	-1.729,21
14/05/2019	166.781.378,41	240.000,00000000	694,92241004	0,07	0,02	2,91	0,20	1.478,19
15/05/2019	166.898.919,60	240.000,00000000	695,41216500	0,07	0,02	2,85	0,22	1.282,93
16/05/2019	167.016.543,63	240.000,00000000	695,90226513	0,07	0,02	2,78	0,25	1.126,72
17/05/2019	167.134.250,56	240.000,00000000	696,39271065	0,07	0,02	2,71	0,27	998,89

Evolução da Rentabilidade

Evolução do Patrimônio
